

DAFTAR ISI

DAFTAR ISI.....	iv
DAFTAR TABEL.....	vi
DAFTAR GAMBAR.....	vii
DAFTAR LAMPIRAN.....	viii
KATA PENGANTAR.....	ix
ABSTRAK.....	xi
ABSTRACT.....	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	3
1.3 Pertanyaan Penelitian.....	4
1.4 Tujuan Penelitian.....	5
1.5 Manfaat Penelitian.....	5
1.6 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	6
1.7 Sistematika Laporan Penelitian.....	6
BAB II LANDASAN TEORI.....	8
2.1 Pasar Modal.....	8
2.2 <i>Efficient Market Hypothesis</i>	8
2.3 Perilaku <i>Herding</i>	10
2.3.1 Jenis <i>Herding</i>	11
2.3.2 Penyebab Perilaku <i>Herding</i> di Pasar Modal.....	12
2.4 Metode Pendeteksian <i>Herding</i>	13
2.4.1 Metode Lakonishok, Shleifer, Vishny (LSV).....	13
2.4.2 Metode Cross Section Standard Deviation (CSSD).....	15
2.4.3 Metode <i>Cross Sectional Absolute Deviation</i> (CSAD).....	16
2.5 Indeks LQ45.....	18
2.6 Penelitian Terdahulu.....	20

2.7 Pengembangan Hipotesis	22
2.8 Kerangka Penelitian	25
BAB III METODE PENELITIAN.....	26
3.1 Data dan Sampel Penelitian	26
3.2 Definisi Operasional Variabel.....	28
3.2.1 Variabel Independen	28
3.2.2 Variabel Dependen.....	30
3.2.3 <i>Market Up</i> dan <i>Market down</i>	31
3.3 Model Empiris.....	31
3.4 Metode Analisis Data.....	32
3.5 Metode Pengujian Hipotesis	33
BAB IV HASIL PENELITIAN dan PEMBAHASAN.....	35
4.1 Analisis Statistik Deskriptif	35
4.2 Pengujian Hipotesis.....	37
4.3 Pembahasan.....	41
4.3.1 Perilaku <i>Herding</i> pada Periode Sebelum Covid-19 Saat Kondisi Pasar Naik (<i>Market Up</i>) dan Pasar Turun (<i>Market Down</i>)	41
4.3.2 Perilaku <i>Herding</i> pada Periode Selama Covid-19 Saat Kondisi Pasar Naik (<i>Market Up</i>) dan Pasar Turun (<i>Market Down</i>)	43
BAB V SIMPULAN	47
5.1 Simpulan	47
5.2 Keterbatasan Penelitian.....	47
5.3 Saran.....	48
5.4 Implikasi.....	48
DAFTAR PUSTAKA	49
LAMPIRAN.....	52

DAFTAR TABEL

Tabel 3.1 Seleksi Sampel Penelitian Berdasarkan Metode Purposive Sampling..	28
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif Periode Sebelum Pandemi Covid-19 Kondisi Pasar Naik (<i>Market Up</i>)	35
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif Periode Sebelum Pandemi Covid-19 Kondisi Pasar Turun (<i>Market Down</i>)	35
Tabel 4.3 Statistik Deskriptif Periode Selama Covid-19 Kondisi Pasar Naik (<i>Market Up</i>)	35
Tabel 4.4 Statistik Deskriptif Periode Selama Covid-19 Kondisi Pasar Turun (<i>Market Down</i>)	36
Tabel 4.5 Hasil Uji Regresi Periode Sebelum Covid-19 Kondisi Pasar Naik (<i>Market Up</i>)	38
Tabel 4.6 Hasil Uji Regresi Periode Sebelum Covid-19 Kondisi Pasar Turun (<i>Market Down</i>)	38
Tabel 4.7 Hasil Uji Regresi Periode Selama Covid-19 Saat Kondisi Pasar Naik (<i>Market Up</i>)	39
Tabel 4.8 Hasil Uji Regresi Pada Periode Selama Covid-19 Saat Kondisi Pasar Turun (<i>Market Down</i>)	40

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Penelitian	25
--------------------------------------	----

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Nama Sampel Perusahaan	52
Lampiran 2 Hasil Analisa Statistik Deskriptif	53
Lampiran 3 Hasil Regresi.....	54